

学校编码: 10384

分类号_____密级_____

学号: 15420061150861

UDC _____

厦 门 大 学

硕 士 学 位 论 文

海峡西岸经济区居民消费问题研究

——基于面板数据分位数回归的分析与应用

A Study on Resident Consumption in West Coast Strait

Economic Zones: Analysis and Application Based on Quantile

Regression for Panel Data

王秀颖

指导教师姓名: 钱 争 鸣 教授

专 业 名 称: 数 量 经 济 学

论文提交日期: 2009 年 4 月

论文答辩时间: 2009 年 5 月

学位授予日期:

答辩委员会主席: _____

评 阅 人: _____

2009 年 4 月

厦门大学学位论文原创性声明

本人呈交的学位论文是本人在导师指导下,独立完成的研究成果。本人在论文写作中参考其他个人或集体已经发表的研究成果,均在文中以适当方式明确标明,并符合法律规范和《厦门大学研究生学术活动规范(试行)》。

另外,该学位论文为()课题(组)的研究成果,获得()课题(组)经费或实验室的资助,在()实验室完成。请在以上括号内填写课题或课题组负责人或实验室名称,未有此项声明内容的,可以不作特别声明。)

声明人(签名):

年 月 日

厦门大学博硕士论文摘要库

厦门大学学位论文著作权使用声明

本人同意厦门大学根据《中华人民共和国学位条例暂行实施办法》等规定保留和使用此学位论文，并向主管部门或其指定机构送交学位论文（包括纸质版和电子版），允许学位论文进入厦门大学图书馆及其数据库被查阅、借阅。本人同意厦门大学将学位论文加入全国博士、硕士学位论文共建单位数据库进行检索，将学位论文的标题和摘要汇编出版，采用影印、缩印或者其它方式合理复制学位论文。

本学位论文属于

（ ） 1.经厦门大学保密委员会审查核定的保密学位论文，于 年 月 日解密，解密后适用上述授权。

（ ） 2.不保密，适用上述授权。

（请在以上相应括号内打“√”或填上相应内容。保密学位论文应是已经厦门大学保密委员会审定过的学位论文，未经厦门大学保密委员会审定的学位论文均为公开学位论文。此声明栏不填写的，默认为公开学位论文，均适用上述授权。）

声明人（签名）：

年 月 日

厦门大学博硕士论文摘要库

摘要

消费问题一直是经济领域研究的热点，而在当前国际金融危机的严峻形势下，如何启动内需拉动消费，以此作为保持我国经济持续稳定快速的生长的重要因素，更成为我国经济研究中重要课题。

纵观改革开放30年，我国经济实现了快速发展，依靠的主要动力是投资和出口，而作为拉动经济增长“三驾马车”之一的消费，却一直处于低迷状态。最近几年，我国的最终消费率偏低，其中居民消费率偏低状况更为突出。居民消费占最终消费总额的比重和居民消费占GDP的比重(居民消费率)都呈现下降趋势。消费不足已不仅导致我国当前经济结构失衡，而且也成为制约经济持续稳定增长和实现“十一五”经济战略目标的瓶颈。

本文针对当前国家十分关注的海峡西岸经济区存在的消费需求不足问题进行研究分析，并将当前计量经济方法前沿研究领域的分析模型——面板数据的分位数回归模型，应用于消费理论中，以克服传统消费问题研究中主要采用普通最小二乘法存在的一些缺陷，不仅丰富了消费理论的经济计量模型，也为以后对分位数回归的研究提供了一个很好的方向。

本文的创新之处主要在于：(1)通过对海峡西岸经济区居民消费水平的面板数据进行分析研究，得出海西各地区的自发消费水平存在差异。(2)对分位数回归方法在Panel Data模型中的应用做了深入的分析，并对不同回归估计方法在Panel Data型中的估计效果进行了比较分析。(3)分别采用最小二乘法和分位数回归法对海西居民的人均消费和人均收入的回归方程的估计结果进行比较，得出分位数回归方法在Panel Data模型中效果显著。(4)引入消费理论的动态模型，对城镇居民和农村居民分别进行分位数回归分析，由此得出一些有意义的分析结论，在此基础上笔者就进一步促进海峡西岸经济区居民的消费需求，提出了相关对策与政策建议。

关键词：居民消费；固定效应；分位数回归

厦门大学博硕士论文摘要库

Abstract

Study on consumption is always a very important problem in economic field. but under the stern situation of the international finance crisis, how to initiate the domestic need to stimulate consumption which is a important factor in keeping our country economy sustained and stable development has become a more important subject in our economic research field.

Looking over 30 years' reform-opening, our country economy has realized fast development, the main powers which depends on are the investment and the exportation, but the consumption which is one of the troika pulling economic growth is still in the poor state. Recently, our country's final consumption rate was on the low side, in which resident consumption rates was more prominent. The proportion of resident consumption in final consumption and the proportion of resident consumption in GDP (resident consumption rates) both showed downtrend. Insufficient consumption has already caused our country current economic structure to be unbalanced, and has become the bottleneck which has been restricting economy to grow sustainingly and stably and hindering the realization of the eleventh five-year economical strategic target.

This article aims at the problem of insufficient consumption in the west coast strait economic zones which has attracted great attention of the current country to carry on the research analysis, in order to overcome the defects of ordinary least squares widely used in researches on the problem of traditional consumptions, this article introduces analysis model in the front research area of econometric approach – quantile regression for panel data, and applies the model to the consumption theory which enriches not only econometric models in the consumption theory, but also provides a very good direction to make better research for the quantile regression. analysis in the least squares method.

The innovation in the paper mainly lies in: (1)accord to the analysis and research to the resident consumption in west coast strait economic zones, draw a conclusion that the spontaneous consumption level exists differences in the various areas of Heisey. (2)make a more deeply analysis about the application of quantile regression method in panel data model, and compare the results obtained by different regression estimate methods in panel data model. (3)use least squares method and quantile regression to compare estimate results about the equation of per person consumption and income in Heisey residents, show that the quantile regression method is remarkable in panel

data. (4)introduce the dynamic model of consumption theory and make a analysis of quantile regression for urban residents and rural residents to obtain some significant conclusions, so I provide some suggestions and correlated policies for the problem of president consumption on the basis of conclusions.

Key Words: resident consumption; the fixed effect; quantile regression

厦门大学博硕士论文摘要库

目录

第一章 绪论	1
1.1 研究的背景	1
1.2 研究的意义	1
1.3 研究内容与研究思路	2
1.3.1 研究的内容	2
1.3.2 研究的基本思路	3
1.3.3 文章结构	3
第二章 西方主要的消费函数理论及其在我国的研究与应用	5
2.1 西方主要的消费函数理论	5
2.1.1 消费与收入关系的短期研究	5
2.1.2 消费与收入关系的长期研究	6
2.1.3 消费函数理论的新发展	8
2.2 消费函数理论在我国的研究与应用	9
2.3 消费研究的主要计量分析方法	11
2.3.1 协整与误差修正模型	12
2.3.2 离散选择模型	13
2.3.3 Panel Data 模型	15
第三章 面板数据的分位数回归方法	20
3.1 分位数回归模型	21
3.1.1 分位数回归原理	21
3.1.2 分位数回归模型的最优化算法	24
3.1.3 分位数回归模型的假设检验	28
3.2 Panel Data 模型与分位数回归方法	29
第四章 研究对象的选取和模型设定	32
4.1 数据来源	32
4.2 变量设置	33
4.3 模型设定	33

4.4 模型识别	34
第五章 海西经济区居民消费的实证研究	39
5.1 方法比较	39
5.2 结果分析	43
5.3 政策建议	51
5.4 研究结果	53
结束语	54
参考文献	56
附录	59
致谢	63

CONTENT

Chapter One: Introduction	1
1.1 Research Background	1
1.2 Research Significance	1
1.3 Research Content and Research Methods	2
1.3.1 Research Content	2
1.3.2 Research Approach	3
1.3.3 Paper Structure	3
Chapter Two: The Main Western Theories of Consumption Function and Its Research and Application in China	5
2.1 The Main Western Theories of Consumption Function	5
2.1.1 Short-term Study on Relationship between Consumption and Income	5
2.1.2 Long-term Study on Relationship between Consumption and Income	6
2.1.3 New Development in Theory of Consumption Function.....	8
2.2 The Research and Application in China	9
2.3 The Main Quantitative Method about Consumption	11
2.3.1 Co-integration and Error Correction Model.....	12
2.3.2 Discrete Choice Model.....	13
2.3.3 Panel Data Model.....	15
Chapter Three: Quantile Regression of Panel Data	20
3.1 Quantile Regression Model	21
3.1.1 Principle of Quantile Regression Model	21
3.1.2 The Optimization Algorithms of Quantile Regression Model	24
3.1.3 Hypothesis Testing of Quantile Regression Model.....	28
3.2 Panel Data Model and Quantile Regression Method.....	29
Chapter Four: Data Source, Variable Design and Model Configuration ...	32
4.1 Data Source.....	32
4.2 Variable Design	33

4.3 Model Configuration	33
4.4 Model Identification	34
Chapter Five: An Empirical Study of Resident Consumption in	
West Coast Strait Economic Zones	39
5.1 Comparison of Methods	39
5.2 Result Analysis.....	43
5.3 Policy Suggestion.....	51
5.4 Research Conclusion.....	53
Summary.....	54
Reference.....	56
Appendix.....	59
Acknowledgements	63

第一章 绪论

1.1 选题背景

改革开放以来，中国长期保持投资和出口的快速增长，消费在改革开放最初的十年里也保持着较快的增长，但是从1997年秋季以来增长缓慢，出现了消费不足的现象。在政府采取强有力措施的作用下，消费有一定程度的增长。但近年来我国最终消费率持续走低，2000年我国最终消费率尚达到61.1%，而到了2003年则锐减到55.4%，2004年进一步下降到53.6%。城乡居民消费水平增长缓慢，消费远没有真正启动。

中国的最终消费率低，反映了中国的经济增长模式是以投资和出口为主的。实际情况是出口受到重视，外贸顺差过大；信贷投放过多，投资增长过快；消费拉动经济增长的作用没有充分发挥出来，消费在国民生产总值中的比重呈下降趋势。如果出口和投资受挫，经济增长就会遇到困难。曾任世界银行副行长的美国发展经济学家钱纳里提出的多国模型，证明了小国家实行的是以出口为主的经济增长模式，大国则实行以内需为主的经济增长模式。模型中的数据说明中国的贸易依存度是相当高的。作为一个大国，贸易依存度不能过高，否则必然挤压国内消费。

受外部需求减弱影响，今年以来我国出口增幅回落。此外，宏观调控政策效应的显现，也从一定程度上抑制了投资的过快增长。在驱动经济增长的“三驾马车”中，与投资、出口相比，今年以来我国消费增长呈加快之势。但是在全球金融市场动荡、世界经济下滑的背景下，进一步增强消费对经济增长的拉动作用已成为“当务之急”。

1.2 研究的意义

消费在经济发展中起着非常重要的作用，直接体现了社会主义生产的目的，是拉动经济增长和保持经济持续增长的重要动力。

从宏观经济运行的角度看，消费在社会再生产四环节中既作为终点又作为逻辑的起点。将消费置于社会经济运行轨道之中考察，一方面它从人们获得消费资料满足的程度和取得消费服务的方式上，体现了整个社会再生产运转的效果；另一方面，他又检验着各个环节运行的状况和效率，并通过自己的检验作

出评价,向再生产过程发出各种信息,提供改善循环的依据和具体要求,以便为新的社会再生产创造出新的消费需求。

从微观层面来看,首先,消费的增长直接扩大了消费性需求,从而推动消费性供给增长,而消费性供给的增长又会扩大生产性需求,从而推动生产性供给增长。其次,消费增长还会带动投资的增长,因为无论消费性供给增长还是生产性供给增长,都必须借助投资的增长来实现。从根本上说,投资是为消费服务的,投资需求是消费需求派生,没有消费的增长,投资就不会无限制的循环下去。可见,消费对生产和投资具有明显的引导作用。只有消费需求才是经济增长的持久拉动力量。

在现阶段的内需中,消费需求每增长1%对经济增长的拉动作用相当于投资增长1.5%对经济增长所产生的拉动作用。此外消费也是阻止经济剧烈波动的稳定力量,消费需求在经济波动中的稳定性表现为它的波动总是小于GDP和需求的波动,并且往往滞后于投资需求的波动。所以保持相对稳定的消费支出是经济周期的重要因素之一。

鉴于消费在经济发展中的重大作用,以及最终消费率不足带来的严重后果,在“十一五”时期要顺利实现相应的战略目标,必须真正启动消费,充分发挥消费对经济增长的拉动作用。

1.3 研究内容与研究思路

1.3.1 研究的内容

所谓消费是指使用物质资料及劳务以满足人们的某种需要的行为过程。通常可以将消费分为生产性消费和生活性消费。其中,生产性消费是指生产过程中物的消费。生活性消费指消费者使用消费资料和劳务,以满足个人生活需要和社会生活需要的行为过程,而生活性消费又可划分为社会消费和个人消费即居民消费两类。其中居民消费是构成消费的重要组成部分,同时社会生产的最终目的是为满足人们的需要。因而对居民消费的研究,尤其是实证研究一直是政府部门、经济学家关注的焦点。

消费问题研究的核心是消费者的消费支出水平,而消费函数正是研究消费支出水平,反映消费与支出之间某种函数关系的理论。这种关系既可以是个人消费与个人可支配收入之间的某种量上的关系,也可以是社会总消费与社会总

收入之间某种量上的关系。就居民个人消费支出与个人可支配收入而言，在个人可支配收入既定的前提下，消费支出与收入的关系取决于个人消费行为所决定的个人消费水平。因而本文在消费问题方面，关注的是居民消费水平。研究居民消费行为，认识居民消费水平的规律，对于我们把握市场，科学的实现宏观调控，保证经济持续、平稳、有序的发展，以及促进商品市场和资本市场的融合，都具有重要的意义。

1.3.2 研究的基本思路

本文在总结前人研究成果的基础之上，建立居民消费的定量分析框架，并以此为基础，利用海峡西岸经济区域城镇居民和农村居民人均消费与人均收入的统计资料对居民消费行为进行实证研究。

本文的主要研究思路、技术路线见图1.1。

1.3.3 文章结构

本文包含五章和一个总结，总共六个部分。本章主要介绍了选题背景、研究的意义和内容。第二章描述了西方主要的消费函数理论以及西方消费函数理论在中国的应用，并在此基础上介绍了近些年来主要的计量经济模型，主要包括误差修正模型、离散选择模型和Panel Data模型。并且说明了本文选择Panel Data模型的原因所在。第三章详细介绍了分位数回归模型的基本原理、最优化算法和假设检验，重点分析了分位数回归方法与Panel Data模型相结合的主要形式和估计原理。第四章基于研究对象的选择和模型的设定。第五章首先引入最基本的消费函数理论，对最小二乘法 and 分位数回归方法的估计结果进行了比较，较好的论证了分位数回归法在Panel Data模型中估计效果的显著性。然后针对海西居民消费的面板数据进行了实证研究，对估计结果进行了分析，并提出了相应的政策建议。文章的最后一个部分对全文进行了总结。

Degree papers are in the "[Xiamen University Electronic Theses and Dissertations Database](#)". Full texts are available in the following ways:

1. If your library is a CALIS member libraries, please log on <http://etd.calis.edu.cn/> and submit requests online, or consult the interlibrary loan department in your library.
2. For users of non-CALIS member libraries, please mail to etd@xmu.edu.cn for delivery details.

厦门大学博硕士论文摘要库